

# 上智大学数理科学講演会

## 「数学と金融～統計的データ解析の視点から～」

### 開催のお知らせ

下記のように標記の講演会を開催いたしますのでご案内いたします。

上智大学理工学部情報理工学科/同大学院理工学研究科数学領域  
(日本数学協会「数学月間」参加プログラム)

#### 記

日時：2012年7月28日(土) 13:30-17:00

会場：上智大学四谷キャンパス 9号館 353教室

#### プログラム

- 13:30-15:00  
講演者：加藤 剛 (上智大学理工学部准教授)

題目：世の中を調べるときに活躍する数学

講演要旨：ベクトルと内積を学ぶとき「これが何の役に立つの?」と思う高校生は多いそうです。行列の固有値と固有ベクトルを学ぶとき「これが何の役に立つの?」と思う大学生も多いそうです。初学者にとって数学の視点だけではなかなかピンとこないこれらの概念も、統計的データ解析の視点から眺めると、実社会にしっかりと役に立っていることがわかります。この講演は2番目の講演への入門編として、犯罪者の心理分析や好みの類似性を活用した相性診断などを例に挙げて、統計的データ解析において数学が果たす役割をご紹介します。

- 15:30-17:00  
講演者：青木義充 (株式会社QUICK)

題目：金融データ解析の実践～リスク計測の実例～

講演要旨：最近、ニュースなどで金融の「リスク」について耳にする機会が増えました。「リスク」は一般的な用語ですから、まったく理解できないという方はいらっしゃるでしょう。しかし、具体的な内容となると、意外と難しいものではないでしょうか?この講演では、数式を用いて「リスク」を具体的に定義します。また、統計的データ解析の立場から、基本的な金融データの扱い方をはじめとし、統計モデルを通じた少し高度なデータの眺め方を紹介します。

連絡先：上智大学理工学部情報理工学科 筱田健一 (Tel: 03-3238-3466, Email: shinoda@sophia.ac.jp)